

## 2023年度第2四半期（上半期）報告 補足資料

1. 一般勘定	
a. 有価証券関係	
(1) 有価証券明細表	1 頁
(2) 地域別地方債保有内訳	1 頁
(3) 有価証券残存期間別残高	2 頁
(4) 業種別株式保有の状況	3 頁
b. 貸付金関係	
(1) 貸付金明細表	4 頁
(2) 国内企業向け貸付金企業規模別内訳	4 頁
(3) 貸付金残存期間別残高	5 頁
(4) 貸付金業種別内訳	6 頁
(5) 貸付金担保別内訳	7 頁
(6) 貸付金地域別内訳	7 頁
c. 海外投融資の状況	
(1) 資産別明細	8 頁
(2) 海外投融資の地域別構成	9 頁
(3) 外貨建資産の通貨別構	9 頁
2. 個人変額保険・変額個人年金保険 特別勘定	
a. 売買目的有価証券の評価損益	10 頁
b. 金銭の信託の時価情報	10 頁
c. デリバティブ取引の時価情報	11 頁
3. 会社計	
a. 資産の構成	13 頁
b. 有価証券の時価情報	14 頁
c. 金銭の信託の時価情報	15 頁
d. デリバティブ取引の時価情報	16 頁

## 1. 一般勘定

### a. 有価証券関係

#### (1) 有価証券明細表

(単位：百万円、%)

区 分	2022年度末		2023年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
国 債	11,530,860	40.9	11,130,820	36.8
地 方 債	179,858	0.6	176,662	0.6
社 債	3,265,782	11.6	3,247,564	10.8
うち公社・公団債	2,061,529	7.3	2,004,630	6.6
うち外貨建	510,464	1.8	510,764	1.7
株 式	2,322,637	8.2	2,907,389	9.6
外 国 証 券	10,582,451	37.5	12,304,443	40.7
公 社 債	8,370,096	29.7	9,514,204	31.5
うち外貨建	6,536,038	23.2	7,366,833	24.4
株 式 等	2,212,355	7.8	2,790,239	9.2
うち外貨建	2,083,495	7.4	2,653,727	8.8
そ の 他 の 証 券	343,641	1.2	442,872	1.5
合 計	28,225,231	100.0	30,209,754	100.0
うち外貨建	9,129,998	32.3	10,531,325	34.9

#### (2) 地域別地方債保有内訳

(単位：百万円)

区 分	2022年度末	2023年度 第2四半期(上半期)末
北 海 道	131	430
東 北	-	-
関 東	82,195	79,424
中 部	38,923	38,465
近 畿	35,745	35,766
中 国	3,207	3,068
四 国	-	-
九 州	19,655	19,506
合 計	179,858	176,662

(3) 有価証券残存期間別残高

<2022年度末>

(単位：百万円)

区 分	1年以下	1年超 3年以下	3年超 5年以下	5年超 7年以下	7年超 10年以下	10年超	期間の定め ないもの	合 計
有 価 証 券	641,677	1,635,200	2,153,332	2,834,342	4,378,369	11,794,162	4,788,145	28,225,231
国 債	481,101	256,651	796,073	1,636,390	2,645,440	5,715,201	-	11,530,860
地 方 債	2,896	5,896	-	2,695	17,049	151,321	-	179,858
社 債	95,835	183,475	399,086	183,932	156,084	1,900,286	347,082	3,265,782
株 式							2,322,637	2,322,637
外 国 証 券	61,844	1,188,363	957,210	1,009,969	1,542,968	4,026,333	1,795,761	10,582,451
公 社 債	61,844	1,188,363	943,717	945,281	1,349,429	3,881,460	-	8,370,096
株 式 等	0	-	13,493	64,687	193,539	144,873	1,795,761	2,212,355
その他の証券	-	813	962	1,354	16,827	1,019	322,663	343,641
買入金銭債権	142,995	-	-	-	-	153,716	-	296,712
譲渡性預金	542,253	-	-	-	-	-	-	542,253
そ の 他	-	-	-	-	-	0	14,990	14,990
合 計	1,326,927	1,635,200	2,153,332	2,834,342	4,378,369	11,947,879	4,803,136	29,079,188

<2023年度第2四半期(上半期)末>

(単位：百万円)

区 分	1年以下	1年超 3年以下	3年超 5年以下	5年超 7年以下	7年超 10年以下	10年超	期間の定め ないもの	合 計
有 価 証 券	310,561	1,921,365	1,786,976	3,533,222	4,284,721	12,435,882	5,937,025	30,209,754
国 債	60,842	364,759	724,289	2,036,277	2,251,967	5,692,684	-	11,130,820
地 方 債	703	5,175	-	3,990	15,647	151,145	-	176,662
社 債	117,736	235,064	295,123	219,061	125,154	1,878,978	376,445	3,247,564
株 式							2,907,389	2,907,389
外 国 証 券	131,278	1,315,593	766,796	1,258,987	1,872,979	4,710,434	2,248,373	12,304,443
公 社 債	131,278	1,311,105	756,303	1,179,533	1,618,507	4,517,474	-	9,514,204
株 式 等	0	4,487	10,493	79,453	254,472	192,959	2,248,373	2,790,239
その他の証券	-	774	766	14,905	18,971	2,638	404,816	442,872
買入金銭債権	74,997	-	-	-	-	148,996	-	223,994
譲渡性預金	534,558	-	-	-	-	-	-	534,558
そ の 他	-	-	-	-	-	0	18,803	18,803
合 計	920,116	1,921,365	1,786,976	3,533,222	4,284,721	12,584,878	5,955,829	30,987,110

(注)本表には、金融商品取引法上の有価証券として取り扱うことが適当と認められるもの等を含んでいます。

(4) 業種別株式保有の状況

(単位：百万円、%)

区 分	2022年度末		2023年度 第2四半期(上半期)末		
	金 額	占率	金 額	占率	
水 産 ・ 農 林 業	320	0.0	340	0.0	
鉱 業	100	0.0	162	0.0	
建 設 業	66,288	2.9	97,968	3.4	
製 造 業	食 料 品	76,358	3.3	98,823	3.4
	織 維 製 品	12,335	0.5	12,844	0.4
	パ ル プ ・ 紙	7,141	0.3	8,500	0.3
	化 学	179,119	7.7	215,152	7.4
	医 薬 品	189,460	8.2	221,791	7.6
	石 油 ・ 石 炭 製 品	6,185	0.3	7,526	0.3
	ゴ ム 製 品	8,285	0.4	13,711	0.5
	ガ ラ ス ・ 土 石 製 品	23,485	1.0	38,172	1.3
	鉄 鋼	24,962	1.1	30,413	1.0
	非 鉄 金 属	49,016	2.1	50,438	1.7
	金 属 製 品	9,566	0.4	14,280	0.5
	機 械	183,219	7.9	205,402	7.1
	電 気 機 器	309,327	13.3	369,487	12.7
	輸 送 用 機 器	69,250	3.0	127,388	4.4
	精 密 機 器	22,097	1.0	22,587	0.8
そ の 他 製 品	66,709	2.9	61,790	2.1	
電 気 ・ ガ ス 業	27,967	1.2	35,981	1.2	
運 輸 ・ 情 報 通 信 業	陸 運 業	172,698	7.4	188,850	6.5
	海 運 業	11,003	0.5	13,669	0.5
	空 運 業	3,501	0.2	3,784	0.1
	倉 庫 ・ 運 輸 関 連 業	11,411	0.5	12,509	0.4
	情 報 ・ 通 信 業	74,439	3.2	101,897	3.5
商 業	卸 売 業	198,505	8.5	270,917	9.3
	小 売 業	40,576	1.7	49,841	1.7
金 融 ・ 保 険 業	銀 行 業	159,289	6.9	246,420	8.5
	証 券、商 品 先 物 取 引 業	6,369	0.3	12,362	0.4
	保 険 業	200,388	8.6	226,907	7.8
	そ の 他 金 融 業	17,821	0.8	39,637	1.4
不 動 産 業	34,967	1.5	45,832	1.6	
サ ー ビ ス 業	60,466	2.6	61,990	2.1	
合 計	2,322,637	100.0	2,907,389	100.0	

(注)業種区分は、「証券コード協議会」の「業種別分類項目」に準拠しています。

b. 貸付金関係

(1) 貸付金明細表

(単位：百万円)

区 分	2022年度末	2023年度 第2四半期(上半期)末
保 險 約 款 貸 付	234,873	230,360
契 約 者 貸 付	214,618	210,780
保 險 料 振 替 貸 付	20,255	19,579
一 般 貸 付 (うち非居住者貸付)	1,963,401 (141,112)	2,102,065 (153,150)
企 業 貸 付 (うち国内企業向け)	1,762,288 (1,621,176)	1,790,415 (1,637,265)
国・国際機関・政府関係機関貸付	169,994	280,678
公 共 団 体 ・ 公 企 業 貸 付	29,500	29,500
住 宅 ロ ー ン	1,614	1,469
消 費 者 ロ ー ン	3	3
そ の 他	-	-
合 計	2,198,274	2,332,426

(2) 国内企業向け貸付金企業規模別内訳

(単位：件、百万円、%)

区 分		2022年度末		2023年度 第2四半期(上半期)末	
			占率		占率
大 企 業	貸付先数	171	72.8	171	72.8
	金 額	1,410,418	87.0	1,415,478	86.5
中 堅 企 業	貸付先数	-	-	-	-
	金 額	-	-	-	-
中 小 企 業	貸付先数	64	27.2	64	27.2
	金 額	210,757	13.0	221,786	13.5
国内企業向け 貸 付 計	貸付先数 金 額	235 1,621,176	100.0 100.0	235 1,637,265	100.0 100.0

(注)1. 規模の区分は業種により以下のとおり定義しています。

業 種	①右の②、③、④を除く 全業種		②小売業、飲食業		③サービス業		④卸売業	
	常用する 従業員 300人超 かつ	資本金 10億円以上	常用する 従業員 50人超 かつ	資本金 10億円以上	常用する 従業員 100人超 かつ	資本金 10億円以上	常用する 従業員 100人超 かつ	資本金 10億円以上
大 企 業		資本金 10億円以上		資本金 10億円以上		資本金 10億円以上		資本金 10億円以上
中 堅 企 業		資本金3億円超 10億円未満		資本金5千万円超 10億円未満		資本金5千万円超 10億円未満		資本金1億円超 10億円未満
中 小 企 業	資本金3億円以下または 常用する従業員300人以下		資本金5千万円以下または 常用する従業員50人以下		資本金5千万円以下または 常用する従業員100人以下		資本金1億円以下または 常用する従業員100人以下	

- 貸付先数とは、各貸付先を名寄せした結果の債務者数をいい、貸付件数ではありません。
- 従業員数及び資本金額は、資料作成時点で当社が把握しているものによります。
- サービス業は、「物品貸貸業」、「学術研究・専門・技術サービス業」、「宿泊業」、「生活関連サービス業、娯楽業」、「教育、学習支援業」、「医療・福祉」、及び「その他のサービス」で構成されます。
- 規模の区分は、日本銀行の「貸出先別貸出金(業種別、設備資金新規貸出)」の規模区分に準拠しています。

(3) 貸付金残存期間別残高

<2022年度末>

(単位：百万円)

区 分	1年以下	1年超 3年以下	3年超 5年以下	5年超 7年以下	7年超 10年以下	10年超	期間の定めのないもの	合 計
変 動 金 利	50,914	5,662	48,099	13,199	68,483	91,231	6,000	283,591
固 定 金 利	259,049	233,306	226,014	130,227	274,284	556,926	-	1,679,809
一 般 貸 付 計	309,963	238,969	274,114	143,427	342,768	648,157	6,000	1,963,401

<2023年度第2四半期(上半期)末>

(単位：百万円)

区 分	1年以下	1年超 3年以下	3年超 5年以下	5年超 7年以下	7年超 10年以下	10年超	期間の定めのないもの	合 計
変 動 金 利	60,547	5,764	61,315	8,404	75,638	102,767	30,000	344,438
固 定 金 利	350,394	234,971	215,258	113,615	304,554	538,833	-	1,757,627
一 般 貸 付 計	410,942	240,735	276,573	122,019	380,193	641,601	30,000	2,102,065

(4) 貸付金業種別内訳

(単位：百万円、%)

区分	2022年度末		2023年度 第2四半期(上半期)末		
	金額	占率	金額	占率	
	163,498	8.3	159,127	7.6	
製造業	食料	14,014	0.7	16,530	0.8
	繊維	900	0.0	900	0.0
	木材・木製品	400	0.0	100	0.0
	パルプ・紙	16,700	0.9	18,380	0.9
	印刷	-	-	-	-
	化学	26,316	1.3	24,974	1.2
	石油・石炭	25,800	1.3	25,800	1.2
	窯業・土石	10,056	0.5	10,148	0.5
	鉄鋼	18,100	0.9	10,100	0.5
	非金属製品	4,650	0.2	4,950	0.2
	金属製品	1,021	0.1	1,000	0.0
	はん用・生産用・業務用機械	12,847	0.7	14,212	0.7
	電気機械	16,130	0.8	15,500	0.7
輸送用機械	15,542	0.8	15,521	0.7	
その他の製造業	1,020	0.1	1,010	0.0	
国内向け	農業、林業	-	-	-	-
	漁業	-	-	-	-
	鉱業、採石業、砂利採取業	-	-	-	-
	建設業	10,487	0.5	11,086	0.5
	電気・ガス・熱供給・水道業	241,496	12.3	247,677	11.8
	情報通信業	20,990	1.1	23,000	1.1
	運輸業、郵便業	169,955	8.7	172,821	8.2
	卸売業	339,500	17.3	307,600	14.6
	小売業	4,990	0.3	4,788	0.2
	金融業、保険業	396,523	20.2	433,569	20.6
	不動産業	188,359	9.6	190,037	9.0
	物品賃貸業	107,232	5.5	109,382	5.2
	学術研究、専門・技術サービス業	-	-	-	-
	宿泊業	-	-	-	-
	飲食業	-	-	-	-
	生活関連サービス業、娯楽業	-	-	-	-
	教育、学習支援業	-	-	-	-
	医療・福祉	-	-	-	-
	その他のサービス	8,000	0.4	8,000	0.4
	地方公共団体	-	-	-	-
個人(住宅・消費・納税資金等)	1,618	0.1	1,472	0.1	
合計	1,822,288	92.8	1,948,915	92.7	
海外向け	政府等	-	-	-	-
	金融機関等	141,112	7.2	153,150	7.3
	商工業等	-	-	-	-
合計	141,112	7.2	153,150	7.3	
一般貸付計	1,963,401	100.0	2,102,065	100.0	

(注)1. 国内向けの区分は、日本銀行の「貸出先別貸出金(業種別、設備資金新規貸出)」の業種分類に準拠しています。

2. 「国内向け貸付の合計」ならびに「一般貸付計」には日本国政府向け貸出を含みます。  
(2022年度末 1,696億円、2023年度第2四半期(上半期)末 2,803億円)

(5) 貸付金担保別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	2022年度末		2023年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
担 保 貸 付	10,732	0.5	10,732	0.5
有 価 証 券 担 保 貸 付	-	-	-	-
不 動 産 ・ 動 産 ・ 財 団 担 保 貸 付	10,732	0.5	10,732	0.5
指 名 債 権 担 保 貸 付	-	-	-	-
保 証 貸 付	12,656	0.6	14,343	0.7
信 用 貸 付	1,938,394	98.7	2,075,516	98.7
そ の 他	1,618	0.1	1,472	0.1
一 般 貸 付 計	1,963,401	100.0	2,102,065	100.0
う ち 劣 後 特 約 付 貸 付	125,800	6.4	157,300	7.5

(6) 貸付金地域別内訳

(単位：百万円、%)

区 分	2022年度末		2023年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
北 海 道	9,266	0.5	9,227	0.5
東 北	17,110	0.9	17,517	0.9
関 東	1,502,644	82.5	1,631,116	83.8
中 部	97,100	5.3	97,300	5.0
近 畿	140,366	7.7	147,361	7.6
中 国	15,112	0.8	15,056	0.8
四 国	5,550	0.3	5,490	0.3
九 州	33,520	1.8	24,375	1.3
合 計	1,820,670	100.0	1,947,443	100.0

(注)1. 個人ローン、非居住者貸付、保険約款貸付等は含みません。

2. 地域区分は、資料作成時点で当社が把握している貸付先の本社所在地によります。



c. 海外投融資の状況

(1) 資産別明細

(ア) 外貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	2022年度末		2023年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
公 社 債	7,046,502	58.0	7,877,598	56.7
株 式 等	2,083,495	17.2	2,653,727	19.1
現 預 金 ・ そ の 他	624,015	5.1	636,297	4.6
外 貨 建 資 産 計	9,754,013	80.3	11,167,623	80.3

(イ) 円貨額が確定した外貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	2022年度末		2023年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
貸 付 金	236,846	2.0	232,867	1.7
現 預 金 ・ そ の 他	3,244	0.0	3,229	0.0
円 貨 額 が 確 定 し た 外 貨 建 資 産 計	240,091	2.0	236,096	1.7

(ウ) 円貨建資産

(単位：百万円、%)

区 分	2022年度末		2023年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
公 社 債	1,834,058	15.1	2,147,370	15.4
株 式 等	271,013	2.2	307,570	2.2
そ の 他	40,272	0.3	45,772	0.3
円 貨 建 資 産 計	2,145,344	17.7	2,500,713	18.0

(エ) 合計

(単位：百万円、%)

区 分	2022年度末		2023年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
海 外 投 融 資	12,139,449	100.0	13,904,434	100.0

(注)「円貨額が確定した外貨建資産」は、為替予約等が付されていることにより決済時の円貨額が確定し、当該円貨額を資産の貸借対照表価額としているものです。

## (2) 海外投融資の地域別構成

(単位：百万円、%)

区 分	2022年度末				2023年度第2四半期(上半期)末				
	外国証券	公社債	株式等	非居住者 貸付	外国証券	公社債	株式等	非居住者 貸付	
北 米	金額	4,298,366	3,771,103	527,263	141,112	5,475,851	4,575,405	900,446	153,150
	占率	40.6	45.1	23.8	100.0	44.5	48.1	32.3	100.0
ヨーロッパ	金額	1,828,123	1,709,754	118,368	-	2,201,818	2,030,670	171,147	-
	占率	17.3	20.4	5.4	-	17.9	21.3	6.1	-
オセアニア	金額	630,571	630,571	-	-	671,583	671,583	-	-
	占率	6.0	7.5	-	-	5.5	7.1	-	-
ア ジ ア	金額	161,532	2,019	159,512	-	166,445	3,495	162,950	-
	占率	1.5	0.0	7.2	-	1.4	0.0	5.8	-
中 南 米	金額	3,450,631	2,043,421	1,407,210	-	3,581,362	2,025,667	1,555,695	-
	占率	32.6	24.4	63.6	-	29.1	21.3	55.8	-
中 東	金額	-	-	-	-	-	-	-	-
	占率	-	-	-	-	-	-	-	-
アフリカ	金額	3,533	3,533	-	-	3,524	3,524	-	-
	占率	0.0	0.0	-	-	0.0	0.0	-	-
国際機関	金額	209,692	209,692	-	-	203,857	203,857	-	-
	占率	2.0	2.5	-	-	1.7	2.1	-	-
合 計	金額	10,582,451	8,370,096	2,212,355	141,112	12,304,443	9,514,204	2,790,239	153,150
	占率	100.0	100.0	100.0	100.0	100.0	100.0	100.0	100.0

(注)本表は発行会社の国籍に基づき作成されています。

## (3) 外貨建資産の通貨別構成

(単位：百万円、%)

区 分	2022年度末		2023年度 第2四半期(上半期)末	
	金 額	占率	金 額	占率
米 ド ル	7,314,169	75.0	8,780,005	78.6
豪 ド ル	916,665	9.4	923,854	8.3
ユ ー ロ	905,311	9.3	870,031	7.8
カナダドル	211,719	2.2	287,400	2.6
ニュージーランドドル	244,187	2.5	139,998	1.3
中 国 元	50,381	0.5	53,817	0.5
ベトナムドン	52,260	0.5	52,265	0.5
シンガポールドル	41,183	0.4	41,183	0.4
インドネシアルピア	15,722	0.2	15,726	0.1
そ の 他	2,411	0.0	3,339	0.0
合 計	9,754,013	100.0	11,167,623	100.0

## 2. 個人変額保険・変額個人年金保険 特別勘定

### a. 売買目的有価証券の評価損益

#### (1) 個人変額保険

(単位：百万円)

区 分	2022年度末		2023年度 第2四半期(上半期)末	
	貸借対照表 計上額	当期の損益に含 まれた評価損益	貸借対照表 計上額	当期の損益に含 まれた評価損益
売 買 目 的 有 価 証 券	55,474	9,821	57,623	11,688

#### (2) 変額個人年金保険

(単位：百万円)

区 分	2022年度末		2023年度 第2四半期(上半期)末	
	貸借対照表 計上額	当期の損益に含 まれた評価損益	貸借対照表 計上額	当期の損益に含 まれた評価損益
売 買 目 的 有 価 証 券	36,711	2,084	35,450	2,468

### b. 金銭の信託の時価情報

個人変額保険、変額個人年金保険ともに残高がないため、記載していません。

c. デリバティブ取引の時価情報

(1) 個人変額保険

(株式関連)

(単位：百万円)

区分	種 類	2022年度末			2023年度第2四半期(上半期)末				
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
			うち1年超				うち1年超		
取引所	株価指数先物								
	売建	-	-	-	-	-	-	-	
	買建	-	-	-	-	-	-	-	
	合 計								

(通貨関連)

(単位：百万円)

区分	種 類	2022年度末			2023年度第2四半期(上半期)末				
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
			うち1年超				うち1年超		
店頭	為替予約								
	売建	142	-	△2	△2	140	-	△0	△0
	(*ドル)	-	-	-	-	22	-	△0	△0
	(ユーロ)	142	-	△2	△2	117	-	△0	△0
	買建	142	-	2	2	139	-	0	0
	(*ドル)	-	-	-	-	22	-	0	0
	(ユーロ)	142	-	2	2	117	-	0	0
	合 計				△0				△0

(注) 外貨建金銭債権債務等に為替予約が付されていることにより、決済時における円貨額が確定している外貨建金銭債権債務等で、貸借対照表において当該円貨額で表示されているものについては、開示の対象より除いています。

(2) 変額個人年金保険

(株式関連)

(単位：百万円)

区分	種 類	2022年度末			2023年度第2四半期(上半期)末				
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
			うち1年超				うち1年超		
取引所	株価指数先物								
	売建	-	-	-	-	-	-	-	
	買建	449	-	7	7	70	-	△0	
	合 計							△0	

(通貨関連)

(単位：百万円)

区分	種 類	2022年度末			2023年度第2四半期(上半期)末				
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
			うち1年超				うち1年超		
店頭	為替予約								
	売建	64	-	△1	△1	267	-	△0	
	(米ドル)	-	-	-	-	124	-	△0	
	(ユーロ)	64	-	△1	△1	120	-	△0	
	(豪ドル)	-	-	-	-	6	-	△0	
	(英ポンド)	-	-	-	-	14	-	△0	
	買建	64	-	1	1	67	-	0	
	(米ドル)	-	-	-	-	11	-	0	
	(ユーロ)	64	-	1	1	56	-	0	
	合 計				0				△0

(注)外貨建金銭債権債務等に為替予約が付されていることにより、決済時における円貨額が確定している外貨建金銭債権債務等で、貸借対照表において当該円貨額で表示されているものについては、開示の対象より除いています。

### 3. 会社計

#### a. 資産の構成（会社計）

##### （1）資産の構成

（単位：百万円、％）

区 分	2022年度末		2023年度 第2四半期（上半期）末	
	金 額	占率	金 額	占率
現預金・コールローン	2,176,849	6.2	1,671,373	4.5
買入金銭債権	407,646	1.2	329,510	0.9
金銭の信託	14,990	0.0	18,803	0.1
有価証券	28,829,411	81.7	30,811,690	83.6
公 社 債	15,187,946	43.0	14,744,932	40.0
株 式	2,456,106	7.0	3,048,242	8.3
外 国 証 券	10,831,959	30.7	12,550,147	34.1
公 社 債	8,455,063	24.0	9,601,170	26.1
株 式 等	2,376,895	6.7	2,948,976	8.0
その他の証券	353,398	1.0	468,369	1.3
貸付金	2,198,274	6.2	2,332,426	6.3
保険約款貸付	234,873	0.7	230,360	0.6
一般貸付	1,963,401	5.6	2,102,065	5.7
不 動 産	588,024	1.7	646,292	1.8
うち投資用	403,356	1.1	470,793	1.3
繰延税金資産	493,008	1.4	450,394	1.2
そ の 他	590,827	1.7	596,481	1.6
貸倒引当金	△867	△0.0	△777	△0.0
会 社 計	35,298,166	100.0	36,856,196	100.0
うち外貨建資産	10,019,114	28.4	11,442,360	31.0

（注）「不動産」については土地・建物・建設仮勘定を合計した金額を計上しています。

##### （2）資産の増減

（単位：百万円）

区 分	2022年度 第2四半期（上半期）	2023年度 第2四半期（上半期）
	金 額	金 額
現預金・コールローン	503,508	△505,475
買入金銭債権	172,528	△78,135
金銭の信託	3,844	3,813
有価証券	△671,364	1,982,279
公 社 債	△123,870	△443,014
株 式	△51,921	592,135
外 国 証 券	△447,862	1,718,187
公 社 債	△399,766	1,146,107
株 式 等	△48,096	572,080
その他の証券	△47,710	114,970
貸付金	44,976	134,151
保険約款貸付	△5,190	△4,513
一般貸付	50,166	138,664
不 動 産	31,776	58,267
うち投資用	11,607	67,436
繰延税金資産	357,081	△42,613
そ の 他	24,904	5,653
貸倒引当金	54	89
会 社 計	467,310	1,558,029
うち外貨建資産	△225,278	1,423,245

（注）「不動産」については土地・建物・建設仮勘定を合計した金額を計上しています。

b. 有価証券の時価情報(会社計)

(1) 売買目的有価証券の評価損益

(単位：百万円)

区 分	2022年度末		2023年度第2四半期(上半期)末	
	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた評価損益	四半期貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた評価損益
売買目的有価証券	619,170	△19,521	620,740	23,119

(注) 本表には、金銭の信託等の売買目的有価証券を含んでいます。

(2) 有価証券の時価情報(売買目的有価証券以外)

(単位：百万円)

区 分	2022年度末					2023年度第2四半期(上半期)末				
	帳簿価額	時価	差損益	差益	差損	帳簿価額	時価	差損益	差益	差損
満期保有目的の債券	1,531,156	1,729,570	198,413	198,537	△124	1,735,442	1,934,242	198,799	204,147	△5,347
責任準備金対応債券	13,192,905	13,610,612	417,707	975,068	△557,360	13,622,653	13,344,581	△278,071	676,073	△954,145
子会社・関連会社株式	53,077	45,626	△7,451	-	△7,451	53,077	43,455	△9,622	122	△9,744
その他の有価証券	12,881,722	13,250,150	368,428	1,303,032	△934,604	13,943,582	14,460,820	517,237	1,750,586	△1,233,349
公 社 債	3,025,881	2,833,870	△192,011	34,902	△226,913	2,575,099	2,287,929	△287,169	41,265	△328,435
株 式	1,065,125	2,118,405	1,053,280	1,084,853	△31,573	1,315,493	2,701,753	1,386,259	1,408,444	△22,185
外 国 証 券	7,703,747	7,207,489	△496,257	160,382	△656,640	8,971,716	8,382,376	△589,340	266,214	△855,554
公 社 債	6,159,486	5,788,664	△370,822	95,914	△466,736	6,877,573	6,423,226	△454,346	140,538	△594,885
株 式 等	1,544,260	1,418,824	△125,435	64,468	△189,903	2,094,143	1,959,150	△134,993	125,676	△260,669
その他の証券	248,157	251,419	3,261	19,658	△16,396	317,653	330,209	12,555	32,532	△19,977
買入金銭債権	296,510	296,712	201	3,236	△3,034	229,019	223,994	△5,025	2,129	△7,154
譲渡性預金	542,300	542,253	△46	-	△46	534,600	534,558	△41	-	△41
そ の 他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	27,658,862	28,635,959	977,097	2,476,638	△1,499,540	29,354,756	29,783,099	428,343	2,630,930	△2,202,586
公 社 債	15,168,512	15,536,037	367,524	1,016,901	△649,376	14,842,217	14,532,200	△310,016	724,318	△1,034,334
株 式	1,065,964	2,118,958	1,052,994	1,084,853	△31,858	1,316,333	2,702,714	1,386,381	1,408,566	△22,185
外 国 証 券	10,337,417	9,890,578	△446,838	351,989	△798,828	12,114,932	11,459,422	△655,509	463,383	△1,118,893
公 社 債	8,740,918	8,426,680	△314,237	287,521	△601,758	9,968,551	9,457,779	△510,771	337,707	△848,479
株 式 等	1,596,499	1,463,897	△132,601	64,468	△197,069	2,146,381	2,001,643	△144,738	125,676	△270,414
その他の証券	248,157	251,419	3,261	19,658	△16,396	317,653	330,209	12,555	32,532	△19,977
買入金銭債権	296,510	296,712	201	3,236	△3,034	229,019	223,994	△5,025	2,129	△7,154
譲渡性預金	542,300	542,253	△46	-	△46	534,600	534,558	△41	-	△41
そ の 他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

(注) 1. 本表には、金融商品取引法上の有価証券として取り扱うことが適当と認められるもの等を含んでいます。

2. 市場価格のない株式等および組合等は本表から除いています。

市場価格のない株式等および組合等の帳簿価額は以下のとおりです。

(単位：百万円)

区 分	2022年度末	2023年度第2四半期(上半期)末
子会社・関連会社株式	789,941	794,466
その他の有価証券	198,522	227,856
国 内 株 式	21,414	22,819
外 国 株 式	34,558	34,558
そ の 他	142,548	170,478
合 計	988,463	1,022,322

c. 金銭の信託の時価情報(会社計)

(単位：百万円)

区 分	2022年度末					2023年度 第2四半期(上半期)末				
	貸借対照表 計上額	時価	差損益	差益	差損	四半期 貸借対照表 計上額	時価	差損益	差益	差損
金 銭 の 信 託	14,990	14,990	-	-	-	18,803	18,803	-	-	-

(注)時価相当額の算定は、取引金融機関が合理的に算定した価格によっています。

・運用目的の金銭の信託

(単位：百万円)

区 分	2022年度末		2023年度 第2四半期(上半期)末	
	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた 評価損益	四半期貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた 評価損益
運 用 目 的 の 金 銭 の 信 託	14,990	28	18,803	1,824

・運用目的以外の金銭の信託

2022年度末、2023年度第2四半期(上半期)末ともに残高がないため、記載していません。



#### d. デリバティブ取引の時価情報（会社計）

##### 【定性的情報】

##### （１）取引の内容

当社では、資産運用方針および運用する資金特性に応じて、以下のデリバティブ取引を活用しています。

	取引所取引	店頭取引
金利派生商品	－	金利スワップ、金利スワップション
為替派生商品	－	為替予約、通貨スワップ、通貨オプション
株式派生商品	株価指数先物、株価指数オプション	個別株オプション、株価指数オプション、 株価指数先渡
債券派生商品	債券先物、債券先物オプション	債券現物オプション
その他	－	マルチ・アセット指数オプション

##### （２）取組方針

当社では、主に保有する資産または負債の価値が変動するリスクを回避する目的で、デリバティブ取引を活用しています。

また、運用する資金特性にそぐわないデリバティブ取引（例えば、原資産の価格変動に対する当該取引時価の変動率が大きいレバレッジの高い取引等）は行わないこととしています。

##### （３）利用目的

当社では、外貨建資産に係る為替リスク等の回避を目的としたヘッジ取引、もしくはリスクを一定範囲内に限定したデリバティブ取引を行っています。

なお、ヘッジ会計の適用要件を満たすヘッジ取引については、ヘッジ会計を適用しています。

##### （４）リスクの内容

当社が利用しているデリバティブ取引には、現物資産と同様に、市場リスクと信用リスクがあります。

###### ア. 市場リスク

金利、株価、為替等の市場の変動およびキャッシュフローの変動によって保有するポートフォリオやポジションの価値が変動するリスクをいいます。

###### イ. 信用リスク

与信先の信用状態の変化により保有するポートフォリオやポジションの価値が変動するリスクをいいます。（デリバティブ取引の取引相手先のデフォルト（債務不履行）により、保有するポジションから期待する経済効果を得られないリスクを含みます。）

##### （５）リスク管理体制

###### ア. リスク管理の基本方針

保有する資産または負債に対して効果的にデリバティブ取引が活用されているか、また、投資案件ごとに設定した運用方針、運用ルール、報告体制が遵守されているか等を定期的に確認することで、リスクの顕在化を未然に防止することをリスク管理の基本としています。

## イ. リスク管理部署

収益部門から独立した資産運用リスク管理部署が、デリバティブ取引のリスク状況を株式、債券等原資産と合わせて管理しています。

## ウ. リスク管理規定

「資産運用リスク管理方針」および「資産運用リスク管理規程」において、デリバティブ取引についての利用目的、取組対象、およびリスク管理体制等を規定しています。また、資産運用部門の細則等において、各部それぞれの役割に応じた具体的な取組みを規定しています。

## エ. リスク管理

ヘッジ取引を行う場合は、ヘッジ対象である原資産とヘッジ手段としてのデリバティブ取引を合わせてリスクを定量的に把握・分析・管理しています。

ヘッジ取引に該当しない取引を行う場合は、取引限度額、許容リスク量を設定するとともにロス・カット・ルールを策定し、ポジション状況、リスク状況および損益状況を管理しています。

## (6) 定量的情報に関する補足説明

### ア. デリバティブ取引に関わる信用リスクの状況

債権債務の関係が法的に相殺可能である契約については、取引相手先が当社に対して有する与信額を考慮したネットベースのカレント・エクスポージャー方式で信用リスク相当額を算出しています。

(単位：億円)

	契約金額・想定元本額		信用リスク相当額	
	2022年9月末	2023年9月末	2022年9月末	2023年9月末
金利スワップ 金利スワップション(買建)	1,196	1,172	230	245
為替予約	112,698	70,976	2,089	1,648
通貨スワップ 通貨オプション(買建)	6,358	7,168	1,232	927
株式オプション(買建) 株価指数先渡	400	2,549	24	152
マルチ・アセット指数オプション(買建)	1,922	2,304	198	267
合計			1,024	1,248

(注1) 契約金額・想定元本額は、取引を執行する際の計算基礎として位置付けられているものであり、リスク量を表す指標ではありません。

(注2) 取引種類別の信用リスク相当額は、取引相手先が当社に対して有する与信額を考慮しないグロスベースのカレント・エクスポージャー方式で算出しており、合計(ネットベースのカレント・エクスポージャー方式にて算出)とは一致しません。

### イ. 差損益に関する補足説明

ヘッジ取引については、ヘッジ手段とヘッジ対象の対応関係を明確にした上で取り組んでおり、ヘッジ手段としてのデリバティブ取引の損益を単独で認識するのではなく、ヘッジ対象としての資産・負債の損益と合算して認識する必要があります。

したがって、ヘッジ手段とヘッジ対象を一体として管理することで、為替変動リスク、金利変動リスク等が減殺されている効果を確認しています。

【定量的情報】

(1) 差損益の内訳（ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳）（会社計）

（単位：百万円）

区 分	2022年度末						2023年度第2四半期(上半期)末					
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合 計	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合 計
ヘッジ会計適用分	4,015	△200,674	-	-	-	△196,659	△14,831	△463,099	-	-	-	△477,931
ヘッジ会計非適用分	1,147	△200,355	△2,806	776	△1,129	△202,367	△464	△109,071	△2,815	△456	△875	△113,682
合 計	5,163	△401,030	△2,806	776	△1,129	△399,026	△15,295	△572,171	△2,815	△456	△875	△591,614

(注)ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分、及びヘッジ会計非適用分の差損益は、損益計算書に計上されています。  
なお時価ヘッジ適用分の差損益は、2022年度末通貨関連 △229,955百万円、2023年度第2四半期(上半期)末通貨関連 △454,154百万円となっています。

(2) 金利関連（会社計）

（ヘッジ会計が適用されていないもの）

（単位：百万円）

区 分	種 類	2022年度末				2023年度 第2四半期(上半期)末			
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
		うち1年超				うち1年超			
店頭	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払		32,500	1,147	1,147		32,500	△464	△464
	合 計				1,147				△464

(注)差損益欄には、時価を記載しています。

（ヘッジ会計が適用されているもの）

（単位：百万円）

ヘッジ会計の方法	種 類	主なヘッジ対象	2022年度末			2023年度 第2四半期(上半期)末		
			契約額等		時価	契約額等		時価
			うち1年超			うち1年超		
繰延ヘッジ	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	貸付金	13,500	2,500	△11	7,500	2,500	△17
	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	保険負債	217,500	217,500	△13,146	280,000	280,000	△38,171
特例処理	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	貸付金	735	710	0	722	705	△8
	固定金利支払/変動金利受取		100,147	100,147	17,173	112,185	112,185	23,366
	合 計				4,015			△14,831

(3) 通貨関連 (会社計)

(ヘッジ会計が適用されていないもの)

(単位：百万円)

区分	種 類	2022年度末			2023年度第2四半期(上半期)末				
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
			うち1年超				うち1年超		
店頭	為替予約								
	売建	3,623,464	-	△252,498	△252,498	1,433,304	-	△180,438	△180,438
	(米ドル)	1,829,812	-	△123,913	△123,913	1,114,476	-	△133,345	△133,345
	(ユーロ)	1,280,422	-	△124,993	△124,993	269,018	-	△45,309	△45,309
	(豪ドル)	401,852	-	△4,138	△4,138	30,765	-	△1,658	△1,658
	買建	3,524,394	-	54,022	54,022	975,054	-	73,866	73,866
	(米ドル)	1,697,932	-	10,414	10,414	710,903	-	45,447	45,447
	(ユーロ)	1,337,349	-	47,940	47,940	263,826	-	28,418	28,418
	(豪ドル)	396,207	-	△5,848	△5,848	83	-	0	0
	通貨オプション								
	売建								
	コール	83,200	-			-	-		
	(678)			256	422	(-)			
	(米ドル)	83,200	-			-	-		
	(678)			256	422	(-)			
	買建								
	コール	-	-			75,000	-		
	(-)					(357)		543	185
	(米ドル)	-	-			75,000	-		
	(-)					(357)		543	185
プット	914,650	-			120,000	-			
(3,933)			1,632	△2,301	(597)		119	△477	
(米ドル)	914,650	-			120,000	-			
(3,933)			1,632	△2,301	(597)		119	△477	
通貨スワップ									
(米ドル)	-	-			5,156	5,156	△2,207	△2,207	
	-	-			5,156	5,156	△2,207	△2,207	
合 計				△200,355				△109,071	

(注)1. ( )内には、オプション料を記載しています。

2. 差損益欄には、為替予約については時価を記載し、オプション取引についてはオプション料と時価との差額を記載しています。

(ヘッジ会計が適用されているもの)

(単位：百万円)

ヘッジ会計の方法	種 類	主なヘッジ対象	2022年度末			2023年度第2四半期(上半期)末		
			契約額等		時価	契約額等		時価
				うち1年超			うち1年超	
時価ヘッジ	為替予約	外貨建資産						
	売建		4,762,898	702,883	△229,955	4,689,304	518,103	△454,154
	(米ドル)		3,181,135	663,063	△168,052	3,424,993	424,877	△382,326
	(ユーロ)		872,598	-	△51,356	761,890	-	△40,564
	(豪ドル)	524,937	27,290	△10,483	428,371	80,802	△27,660	
繰延ヘッジ	通貨スワップ	外貨建資産	37,806	35,351	△7,039	37,806	35,351	△11,758
	(米ドル)		35,351	35,351	△6,634	35,351	35,351	△11,042
	(ユーロ)		2,454	-	△405	2,454	-	△715
振当処理	通貨スワップ	外貨建資産	236,846	230,642	△29,226	232,867	222,687	△56,208
	(米ドル)		236,846	230,642	△29,226	232,867	222,687	△56,208
	通貨スワップ	外貨建負債	345,510	246,030	65,546	246,030	246,030	59,021
	(米ドル)		345,510	246,030	65,546	246,030	246,030	59,021
合 計				△200,674			△463,099	

#### (4) 株式関連 (会社計)

(ヘッジ会計が適用されていないもの)

(単位：百万円)

区分	種 類	2022年度末			2023年度第2四半期(上半期)末				
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
		うち1年超				うち1年超			
取引所	株価指数先物								
	売建	7,576	-	△77	△77	5,419	-	52	52
	買建	68,783	-	1,104	1,104	58,011	-	△1,463	△1,463
店頭	株価指数オプション								
	売建								
	コール	40,000	-			-			
		(1,046)		390	656	(-)		-	-
	買建								
プット	547,130	-			254,995	-			
	(4,936)		446	△4,489	(1,678)		274	△1,404	
	合 計								△2,815

(注)1. ( )内には、オプション料を記載しています。

2. 差損益欄には、先物取引については時価を記載し、オプション取引についてはオプション料と時価との差額を記載しています。

(ヘッジ会計が適用されているもの)

2022年度末、2023年度第2四半期(上半期)末ともに残高がないため、記載していません。

#### (5) 債券関連 (会社計)

(ヘッジ会計が適用されていないもの)

(単位：百万円)

区分	種 類	2022年度末			2023年度第2四半期(上半期)末				
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
		うち1年超				うち1年超			
取引所	債券先物								
	買建	33,788	-	776	776	43,344	-	△456	△456
	合 計				776			△456	

(注)差損益欄には、時価を記載しています。

(ヘッジ会計が適用されているもの)

2022年度末、2023年度第2四半期(上半期)末ともに残高がないため、記載していません。

#### (6) その他 (会社計)

(ヘッジ会計が適用されていないもの)

(単位：百万円)

区分	種 類	2022年度末			2023年度第2四半期(上半期)末				
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
		うち1年超				うち1年超			
店頭	マルチ・アセット指数オプション								
	売 建								
	コール	97,881	-			97,677	-		
		(291)		182	108	(228)		139	88
	買 建								
コール	186,144	-			230,415	-			
	(4,144)		2,905	△1,238	(4,703)		3,739	△964	
	合 計								△875

(注)1. ( )内には、オプション料を記載しています。

2. 差損益欄には、オプション料と時価との差額を記載しています。

(ヘッジ会計が適用されているもの)

2022年度末、2023年度第2四半期(上半期)末ともに残高がないため、記載していません。